

当研究室で学位取得を希望される方

当研究室では、まず数学理論的研究として、種々の時系列モデル（非正規非線形時系列、局所定常時系列、長期記憶時系列、多変量時系列等）に対して最適推測、最適検定、最適判別理論を局所漸近正規性に基づいて構築してきました。これら理論的結果の応用は広く、例えば、生体時系列解析では脳波と筋電波の相関構造解析、金融分野ではポートフォリオの統計的漸近有効推定、バリューアトリスク問題、また種々の地震波の判別解析、金融データのクラスター分析等に広がってきています。その他、基礎理論的なところでは、時系列の縮小推定量、非正則時系列モデルの推測理論の構築、時系列の経験尤度解析、時系列信号に対する独立成分分析、時系列の予備検定統計量の漸近理論、金融解析での漸近無裁定性の研究等があります。今後の当研究室の目標としては、基礎理論をさらに一般的な時系列モデル、一般的な統計手法に対して構築し、応用は生体工学、金融工学、計量経済学、遺伝子工学等へさらに広げていくつもりであります。

当研究室（谷口研究室）では、上記の分野、及び関連分野で、学位取得を希望する「やるき」のある修士課程及び博士課程（社会人も含む）院生を求めています。興味のある方は

谷口 正信（E-mail: taniguchi@waseda.jp）

にご連絡ください。

当研究室で学位を取得した研究者名、学位題目及び現職は以下です。

2005年 蛭川 潤一 「LAN Theorem for non-Gaussian locally stationary processes and their discriminant analysis」 新潟大学理学部 准教授

2006年 玉置 健一郎 「Statistical higher order asymptotic theory and its applications to analysis of financial time series」 早稲田大学政経学部 准教授

2007年 白石 博 「Statistical estimation of optimal portfolios for dependent returns of assets」 慈恵医科大学医学部 講師

2007年 小方 浩明 「Empirical likelihood method for time series analysis」 首都大学東京都市教養学部 助教

2008年 天野 友之 「Various statistical methods in time series analysis」 早稲田大学基幹理工学部 助教